

THEAM Quant - Equity US Guru C USD Distribution

Categoria Morningstar™		Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™					
Azionari USA Large Cap Blend		Morningstar US Large-Mid Cap NR USD	S&P 500 NR USD	★★					
Usato nel Report									
Obiettivo d'Investimento Dichiarato		Rendimenti							
Il Comparto mira ad aumentare il valore delle proprie attività nel medio termine attraverso un'esposizione a un paniere dinamico di titoli azionari nordamericani, i cui componenti sono scelti applicando un metodo di selezione sistematica basata su un'analisi fondamentale di società, al fine di conseguire il proprio obiettivo d'investimento, il Comparto adotta una strategia d'investimento quantitativa (la Strategia) che assume posizioni lunghe su un paniere diversificato composto da titoli azionari nordamericani attraverso l'Indice BNP Paribas GURU Equity US Long Total Return (Indice di Strategia).									
		2020	2021	2022	2023	2024	2025-12		
		-5,96	31,34	-10,68	16,49	31,90	8,52		
		10,52	35,50	-14,63	21,97	32,89	3,41		
		8,01	34,61	-14,29	20,03	29,09	2,06		
Misure di Rischio		Rend. Cumulati %		Rendimenti					
3Y Alpha	-0,36	3Y Sharpe Ratio	1,13	3-Mesi	9,08	Bmk	5,44	Cat	4,84
3Y Beta	1,02	3Y Std Dev	13,40	6-Mesi	19,70	11,07	10,55	2026	-
3Y R-Squared	84,00	3Y Risk	+Med	1-Anno	11,13	4,49	2,75	2025	-6,94
3Y Info Ratio	-0,04	5Y Risk	Alto	3-Anni Ann.ti	19,02	18,76	16,65	2024	16,80
3Y Tracking Error	5,45	10Y Risk	Alto	5-Anni Ann.ti	14,25	14,38	13,33	2023	4,79
Basati su Morningstar US Large-Mid Cap NR USD (dove applicabile)		10-Anni Ann.ti	10,61	14,58	13,29	2022	-2,77	-11,80	2,01
		Rendimenti aggiornati al 15/01/2026							
Portafoglio -		Style Box Azionaria		Mkt Cap %					
				Fondo					
		Capitalizzazione media di mercato		Fondo					
		Ave Mkt Cap		-					
		Fondo		Fondo					